

# 海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新招募说明书摘要

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

n

## 重要提示

海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）经 2011 年 2 月 23 日中国证券监督管理委员会证监许可【2011】268 号文核准募集。本基金的基金合同于 2011 年 4 月 27 日正式生效。本基金类型为契约型开放式。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。当投资者赎回时，所得或会高于或低于投资者先前所支付的金额。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资债券引发的信用风险，以及本基金投资策略所特有的风险等等。本基金为 ETF 联接基金，紧密跟踪标的指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，投资者在申购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为 2016 年 10 月 27 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 9 月 30 日。

本招募说明书所载的财务数据未经审计。

## 一、基金管理人

### (一) 基金管理人概况

名称：海富通基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

法定代表人：张文伟

成立时间：2003 年 4 月 18 日

电话：021-38650999

联系人：吴晨莺

注册资本：1.5 亿元人民币

股权结构：海通证券股份有限公司 51%、法国巴黎投资管理 BE 控股公司 49%。

### (二) 主要人员情况

张文伟先生，董事长，硕士，高级经济师。历任交通银行河南省分行铁道支行行长、紫荆山支行行长、私人金融处处长，海通证券办公室主任，海通证券投资银行总部副总经理、海富通基金管理有限公司董事、副总经理。2013 年 5 月起任海富通基金管理有限公司董事长。

刘颂(Patrick LIU)先生，董事、总经理，英国籍，工商管理硕士。历任英国伦敦洛希尔父子有限公司投资银行助理，路透伦敦资产管理战略企划部全球总监，路透香港亚太区资产管理及研究总监，香港景顺投资管理有限公司驻北京办事处首席代表，景顺长城基金管理有限公司常务副总裁，德意志资产管理大中华区董事总经理。2015 年 3 月加入海富通基金管理有限公司，现任海富通基金管理有限公司董事、总经理。

黄正红先生，董事，国民经济学硕士，历任海通证券股份有限公司研究所分析员、总经理办公室秘书、主任助理、战略发展部副总经理、总经理，现任海通证券股份有限公司董事会秘书兼战略发展部总经理。

杨明先生，董事，管理学学士。历任中国人民银行新余支行科员，交通银行新余支行办公室科员、证券业务部负责人、证券业务部副主任、证券业务部主任，海通证券有限公司新余营业部总经理，海通证券股份有限公司江苏分公司筹备负责人、总经理、党委副书记，现任海通证券股份有限公司人力资源部总经理、党委组织部部长。

陶乐斯 (Ligia Torres) 女士，董事，法国与墨西哥双重国籍，双硕士学位，曾任职于东方汇理银行、渣打银行和欧洲联合银行，1996 年加入法国巴黎银行集团工作，2010 年 3 月至 2013 年 6 月任法国巴黎银行财产管理部英国地区首席执行官，2010 年 10 月至今任法国巴黎银行英国控股有限公司董事，2013 年 7 月至今任法国巴黎投资管理公司亚太区及新兴市场主管。

黄金源(Alex NG Kim Guan)先生，董事，马来西亚国籍，文学学士，历任荷兰通用投资银

行新加坡代表处客服主任，荷兰通用资本市场远东区域香港公司证券部经理，法国巴黎投资管理亚洲有限公司董事，现任法国巴黎投资管理亚洲有限公司亚太区投资总监。

郑国汉先生，独立董事，经济学硕士及博士学位。历任美国佛罗里达州大学经济系副教授、香港科技大学经济系教授、香港科技大学商学院经济系教授及系主任和商学院副院长、商学院院长及经济系讲座教授，现任香港岭南大学校长。

巴约特（Marc Bayot）先生，独立董事，比利时籍，布鲁塞尔大学工商管理硕士。布鲁塞尔大学经济学荣誉教授，先锋投资（米兰及都柏林）独立副董事长，Fundconnect 独立董事长、Degroof 资产管理（布鲁塞尔）独立董事和法国巴黎银行 B Control SICAV 独立董事。

杨国平先生，独立董事，硕士，高级经济师。历任上海杨树浦煤气厂党委副书记、代书记，上海市公用事业管理局党办副主任，上海市出租汽车公司党委书记，现任大众交通（集团）股份有限公司董事长兼总经理、上海大众公用事业（集团）股份有限公司董事长、上海交大昂立股份有限公司董事长。

张馨先生，独立董事，博士，教授。1984年7月至今任职于厦门大学经济学院，历任厦门大学经济学院教授、副院长兼财政系主任、院长。现任厦门大学经济学院教授、博士生导师。

李础前先生，监事长，经济学硕士，高级经济师。历任安徽省财政厅中企处副主任科员，安徽省国有资产管理局科长，海通证券计划财务部副总经理、总经理和财务总监。

魏海诺（Bruno Weil）先生，监事，法国籍，博士。历任巴黎银行东南亚负责人、亚洲融资项目副经理，法国巴黎银行跨国企业全球业务客户经理、亚洲金融机构投行业务部负责人、零售部中国代表，南京银行副行长。现任法国巴黎银行集团（中国）副董事长。

俞涛先生，监事，博士，CFA。先后就职于上投摩根基金管理有限公司、摩根资产管理（英国）有限公司。曾任上投摩根基金管理有限公司业务发展部总监。2012年11月起任海富通基金管理有限公司产品与创新总监，2015年12月起兼任海富通基金管理有限公司总经理助理。

陈虹女士，监事，法学士。历任香港的近律师事务所上海代表处律师，工银安盛人寿保险有限公司高级法律顾问。2014年7月至2016年1月任海富通基金管理有限公司高级法务经理，现任海富通基金管理有限公司法律部负责人。

奚万荣先生，督察长，经济学硕士，中国注册会计师协会非执业会员。历任海南省建行秀英分行会计主管，海通证券股份有限公司内部审计，2003年4月加入海富通基金管理有限公司，历任监事、监察稽核总监、总经理助理。2015年7月起，任海富通基金管理有限公司督察长兼上海富诚海富通资产管理有限公司监事。

章明女士，副总经理，硕士。历任加拿大 BBCC Tech & Trade Int'l Inc 公司高级财务经理、加拿大 Future Electronics 公司产品专家，国信证券业务经理和副高级研究员，海通证券股份有限公司对外合作部经理。2003年4月至2015年7月任海富通基金管理有限公司督察长，2015年7月起任海富通基金管理有限公司副总经理。

陶网雄先生，副总经理，硕士。历任中国电子器材华东公司会计科长、上海中土实业发展公司主管会计、海通证券股份有限公司财务副经理。2003年4月加入海富通基金管理有限公司，2003年4至2006年4月任公司财务部负责人，2006年4月起任财务总监。

2013年4月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

何树方先生，副总经理，博士。历任山东济宁市财政贸易委员会副科长，魁北克蒙特利尔大学研究助理（兼职），魁北克公共退休金管理投资公司分析师、基金经理助理，富国基金管理有限公司总经理助理，2011年6月加入海富通基金管理有限公司，任总经理助理。2014年11月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

刘瓅女士，硕士。先后任职于交通银行、华安基金管理有限公司，曾任华安上证180ETF基金经理助理；2007年3月至2010年6月担任华安上证180ETF基金经理，2008年4月至2010年6月担任华安中国A股增强指数基金经理。2010年6月加入海富通基金管理有限公司。2010年11月起任海富通上证周期ETF及海富通上证周期ETF联接基金经理，2011年4月起兼任海富通上证非周期ETF及海富通上证非周期ETF联接基金经理。2012年1月起任海富通中证100指数(LOF)基金经理。2012年5月起兼任海富通中证内地低碳指数基金经理。2013年10月起任指数投资部指数投资负责人。

金晓鸣先生，经济学学士。2008年7月加入海富通基金管理有限公司，先后在运营部和权益投资部任职。2014年11月起任上证非周期ETF、海富通上证非周期ETF联接、上证周期ETF、海富通上证周期ETF联接的基金经理助理。

投资决策委员会常设委员有：刘颂，总经理；胡光涛，总经理助理；王智慧，总经理助理；邵佳民，总经理助理；杜晓海，多资产策略投资部总监；黄东升，机构权益投资部总监。投资决策委员会主席由总经理担任。讨论内容涉及特定基金的，则该基金经理出席会议。上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币35,640,625.71万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

## 三、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

名称：海富通基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层

法定代表人：张文伟

全国统一客户服务号码：40088-40099（免长途话费）

电话：021-38650797, 021-38650799

传真：021-33830160, 021-33830161

## 2、场外销售机构

（1）中国工商银行股份有限公司

地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

客户服务电话：95588

电话：010-66107900

传真：010-66107914

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

（2）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

传真：010-66275654

客户服务电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

（3）中国银行股份有限公司

地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

电话：010-66596688

传真：010-66593777

客户服务电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

（4）交通银行股份有限公司

地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

客户服务电话：95559

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

（5）招商银行股份有限公司

地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

客户服务电话: 95555

网址: [www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

(6) 平安银行股份有限公司

地址: 广东省深圳市深南东路 5047 号平安银行大厦

法定代表人: 孙建一

客户服务电话: 95511-3

开放式基金业务传真: 0755-25879453

网址: [www.bank.pingan.com](http://www.bank.pingan.com)

(7) 上海浦东发展银行股份有限公司

地址: 上海市中山东一路 12 号

法定代表人: 吉晓辉

客户服务电话: 95528

网址: [www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

(8) 中国民生银行股份有限公司

地址: 北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人: 洪崎

客户服务电话: 95568

网址: [www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

(9) 华夏银行股份有限公司

地址: 北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人: 吴建

客户服务电话: 95577

网址: [www.hxb.com.cn](http://www.hxb.com.cn)

(10) 中国农业银行股份有限公司

地址: 北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人: 周慕冰

客户服务电话: 95599

传真: 010-85108557

网址: [www.abchina.com](http://www.abchina.com)

(11) 中信银行股份有限公司

地址: 北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人: 常振明

客户服务电话: 95558

网址: <http://bank.ecitic.com/>

(12) 浙商银行股份有限公司

地址: 中国杭州市庆春路 288 号

法定代表人：沈仁康

客户服务电话：95527

网址：[www.czbank.com](http://www.czbank.com)

(13) 江苏江南农村商业银行股份有限公司

住所：江苏省常州市延陵中路 668 号

法定代表人：陆向阳

客户服务电话：96005

公司网站：<http://www.jnbank.cc>

(14) 海通证券股份有限公司

地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：瞿秋平

客户服务电话：021-95553 或 4008888001

联系人：李笑鸣

网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

(15) 国泰君安证券股份有限公司

地址：上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人：杨德红

客户服务电话：95521

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

(16) 安信证券股份有限公司

地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼

法定代表人：牛冠兴

客户服务电话：400-800-1001

联系人：陈剑虹

网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

(17) 渤海证券股份有限公司

地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：王春峰

客户服务电话：400-651-5988

联系人：王兆权

网址：[www.ewww.com.cn](http://www.ewww.com.cn)

(18) 财富证券有限责任公司

地址：湖南长沙芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26~28 层

法定代表人：蔡一兵

电话：400-88-35316

联系人：郭磊

网址: [www.cfzq.com](http://www.cfzq.com)

(19) 长城证券股份有限公司

地址: 深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人: 黄耀华

客户服务电话: 4006666888

联系人: 高峰

网址: [www.cgws.com](http://www.cgws.com)

(20) 德邦证券股份有限公司

住所: 上海市福山路 500 号城建国际中心 26 层

法定代表人: 姚文平

客户服务电话: 4008888128

联系人: 罗芳

网址: [www.tebon.com.cn](http://www.tebon.com.cn)

(21) 第一创业证券股份有限公司

地址: 深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法定代表人: 刘学民

客户服务电话: 4008881888

联系人: 毛诗莉

网址: <http://www.fcsc.com>

(22) 东北证券股份有限公司

地址: 吉长春市自由大路 1138 号

法定代表人: 杨树财

客户服务电话: 4006000686

网址: [www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

(23) 东莞证券有限责任公司

地址: 广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人: 张运勇

客户服务电话: 95328

联系人: 梁建伟

网址: [www.dgzq.com.cn](http://www.dgzq.com.cn)

(24) 光大证券股份有限公司

地址: 上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人: 郭新双

客户服务电话: 95525

联系人: 刘晨、李芳芳

网址: [www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(25) 广州证券股份有限公司

地址: 广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 19 楼

法定代表人: 刘东

客户服务电话: 95396

联系人: 林洁茹

网址: [www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

(26) 国都证券有限责任公司

地址: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层、10 层

法定代表人: 常喆

客户服务电话: 400-818-8118

联系人: 黄静

网址: [www.guodu.com](http://www.guodu.com)

(27) 国信证券股份有限公司

地址: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16 层到 26 层

法定代表人: 何如

客户服务电话: 95536

联系人: 齐晓燕

网址: [www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(28) 国元证券股份有限公司

地址: 安徽省合肥市梅山路 18 号

法定代表人: 蔡咏

客户服务电话: 95578

联系人: 李蔡

网址: [www.gyzq.com.cn](http://www.gyzq.com.cn)

(29) 红塔证券股份有限公司

地址: 云南省昆明市北京路 155 号附一号红塔大厦 7-11 楼

法定代表人: 况雨林

客户服务电话: 4008718880

联系人: 刘晓明

网址: [www.hongtastock.com](http://www.hongtastock.com)

(30) 华龙证券有限责任公司

地址: 甘肃省兰州市东岗西路 638 号

法定代表人: 李晓安

客户服务电话: 4006898888

联系人: 邓鹏怡

网址: [www.hlzqgs.com](http://www.hlzqgs.com)

(31) 华泰联合证券有限责任公司

地址: 深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 25、24、10 层

法定代表人: 吴晓东

客户服务电话: 95513

网址: [www.lhzq.com](http://www.lhzq.com)

(32) 江海证券有限公司

地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人: 孙名扬

联系人: 刘爽

客服电话: 400-666-2288

网址: [www.jhzq.com.cn](http://www.jhzq.com.cn)

(33) 民生证券股份有限公司

地址: 北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 层 16-18 层

法定代表人: 余政

客户服务电话: 4006198888

联系人: 赵明

网址: <http://www.mszq.com/>

(34) 平安证券股份有限公司

地址: 深圳市福田中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人: 谢永林

客户服务电话: 95511 转 8

联系人: 吴琼

网址: [stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

(35) 中泰证券股份有限公司

地址: 山东省济南市经七路 86 号

法定代表人: 李玮

客户服务电话: 95538

联系人: 孙豪志

网址: [www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

(36) 日信证券有限责任公司

地址: 呼和浩特市新城区锡林南路 18 号

法定代表人: 孔佑杰

客户服务电话: 010-88086830

联系人: 陈文彬

网址: [www.rxzq.com.cn](http://www.rxzq.com.cn)

(37) 山西证券股份有限公司

地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

客户服务电话：400-666-1618

联系人：张治国

网址：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

(38) 上海证券有限责任公司

地址：上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：龚德雄

客户服务电话：4008918918, 021-962518

联系人：陈翔

网址：[www.962518.com](http://www.962518.com)

(39) 申万宏源证券有限公司

地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人：李梅

客户服务电话：95523, 4008895523

联系人：黄莹

网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

(40) 中国银河证券股份有限公司

地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

客户服务电话：4008-888-888

联系人：宋明

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(41) 英大证券有限责任公司

地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

法定代表人：吴骏

客户服务电话：0755-26982993

联系人：李欣

网址：[www.ydsc.com.cn](http://www.ydsc.com.cn)

(42) 中国国际金融股份有限公司

地址：北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

公司总机：010-65051166 (北京)；021-58796226 (上海)

联系人：王少立

网址：[www.cicc.com.cn](http://www.cicc.com.cn)

(43) 中山证券有限责任公司

地址： 深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

法定代表人： 黄扬录

客户服务电话： 4001022011

联系人： 罗艺琳

网址： [www.zszq.com.cn](http://www.zszq.com.cn)

（44） 中国中投证券有限责任公司

地址： 深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 18 层至 21 层

法定代表人： 龙增来

客户服务电话： 95532 或 4006008008

联系人： 刘毅

网址： <http://www.china-invs.cn/>

（45） 中信建投证券股份有限公司

地址： 北京市朝阳门内大街 188 号

法定代表人： 王常青

客户服务电话： 400-8888-108

网址： [www.csc108.com](http://www.csc108.com)

（46） 中信证券股份有限公司

地址： 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

法定代表人： 张佑君

电话： 95548

网址： [www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

（47） 招商证券股份有限公司

地址： 深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人： 宫少林

客户服务电话： 95565

联系人： 林生迎

网址： [www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

（48） 华泰证券股份有限公司

地址： 江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人： 吴万善

客户服务电话： 95597

联系人： 肖亦玲

网址： [www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

（49） 长江证券股份有限公司

地址： 武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人： 杨泽柱

客户服务电话: 95579

联系人: 李良

长江证券客户服务网站: [www.95579.com](http://www.95579.com)

(50) 中信证券(山东)有限责任公司

地址: 青岛市崂山区深圳路 222 号天泰金融广场 A 座 20 层

法定代表人: 杨宝林

客户服务电话: 95548

联系人: 吴忠超

网址: [www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

(51) 广发证券股份有限公司

法定代表人: 孙树明

注册地址: 广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼 (4301-4316 房)

办公地址: 广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

联系人: 黄岚

统一客户服务热线: 95575 或致电各地营业网点

公司网站: [www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

(52) 中航证券有限公司

地址: 南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人: 王宜四

电话: 4008866567

联系人: 戴蕾

网址: [www.scstock.com](http://www.scstock.com)

(53) 中国民族证券有限责任公司

地址: 北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40F-43F

法定代表人: 赵大建

客户服务电话: 400-889-5618

联系人: 李微

网址: [www.e5618.com](http://www.e5618.com)

(54) 华宝证券有限责任公司

地址: 上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 楼

法定代表人: 陈林

客户服务电话: 4008209898

联系人: 刘闻川

网址: [www.cnhbstock.com](http://www.cnhbstock.com)

(55) 信达证券股份有限公司

地址: 北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

客户服务电话：400-800-8899

联系人：唐静

网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

(56) 华福证券有限责任公司

地址：福州五四路新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

客户服务电话：0591-96326

联系人：张腾

网址：[www.gfhfzq.com.cn](http://www.gfhfzq.com.cn)

(57) 东兴证券股份有限公司

地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层

法定代表人：魏庆华

客户服务电话：4008-888-993

联系人：黄英

网址：[www.dxzq.net](http://www.dxzq.net)

(58) 天相投资顾问有限公司

地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

法定代表人：林义相

客户服务电话：010-66045678

联系人：尹伶

网址：[www.txsec.com](http://www.txsec.com)

(59) 华西证券股份有限公司

地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号

法定代表人：杨炯洋

客户服务电话：400-888-8818 95584

联系人：周志茹

网址：[www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

(60) 西藏东方财富证券股份有限公司

地址：上海市闸北区永和路 118 弄 24 号

法定代表人：贾绍君

客户服务电话：40088-11177

联系人：周艳琼

网址：<http://www.xzsec.com/>

(61) 财达证券有限责任公司

地址：河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦 23-26 层

法定代表人：翟建强

客户服务电话：4006128888

联系人：李卓颖

网址：<http://www.s10000.com/>

(62) 太平洋证券股份有限公司

地址：云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层

法定代表人：李长伟

客户服务电话：4006650999

联系人：谢兰

网址：<http://www.tpyzq.com/>

(63) 开源证券股份有限公司

地址：西安市锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法定代表人：李刚

客户服务电话：400-860-8866

网址：<http://www.kysec.cn/>

(64) 华金证券有限责任公司

地址：上海市浦东新区杨高南路 759 号 30 层

法定代表人：宋卫东

客户服务电话：4008-211-357

联系人：秦臻

网址：<http://www.huajinsc.cn/>

(65) 申万宏源西部证券有限公司

住所：新疆乌鲁木齐高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：李季

客户服务电话：4008000562

网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

(66) 中信期货有限公司

地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

客户服务电话：4009908826

联系人：韩钰

网址：<http://www.citicsf.com/>

(67) 天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦 4 楼

办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

法定代表人：余磊

客户服务电话：4008005000

联系人：杨晨

官网：<http://www.tfqzq.com>

(68) 宏信证券有限责任公司

地址：四川省成都市人民南路二段 18 号川信大厦 10 楼

法定代表人：吴玉明

客户服务电话： 4008366366

联系人：张鋆

网址：<http://www.hxzq.cn>

(69) 深圳众禄基金销售有限公司

地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

客户服务电话：4006-788-887

联系人：童彩平

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(70) 杭州数米基金销售有限公司

地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

客户服务电话：4000-766-123

联系人：李雁雯

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(71) 上海好买基金销售有限公司

地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

法定代表人：杨文斌

客户服务电话：400-700-9665

联系人：陆敏

网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(72) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：单丙烨

客服电话：400-820-2899

公司网站：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(73) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

法定代表人：汪静波

客户服务电话：400-821-5399

联系人：李娟

网址：www.noah-fund.com

(74) 上海天天基金销售有限公司

地址：徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼

法定代表人：其实

客户服务电话：400-1818-188

联系人：王超

网址：www.1234567.com.cn

(75) 和讯信息科技有限公司

地址：上海市浦东新区东方路 18 号保利广场 E 座 18F

法定代表人：王莉

客户服务电话：400-920-0022

联系人：吴卫东

网址：licaike.hexun.com

(76) 北京展恒基金销售有限公司

地址：北京顺义区后沙峪镇安富街 6 号

法定代表人：闫振杰

客户服务电话：400-888-6661

联系人：马林

网址：www.myfund.com

(77) 浙江同花顺基金销售有限公司

地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 楼

法定代表人：凌顺平

客户服务电话：0571-88920897 、4008-773-772

联系人：董一峰

网址：www.5ifund.com

(78) 众升财富（北京）基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内

法定代表人：王斐

客户服务电话：400-081-6655

联系人：付少帅

网址：www.wy-fund.com

(79) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

法定代表人：陈操

地址: 深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006 室

联系人: 文雯

客户服务电话: 400-850-7771

网址: <https://t.jrj.com/>

(80) 一路财富(北京)信息科技有限公司

法定代表人: 吴雪秀

地址: 北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702

联系人: 徐越

客服电话: 400-001-1566

网址: [www.yilucaifu.com](http://www.yilucaifu.com)

(81) 上海联泰资产管理有限公司

法定代表人: 燕斌

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

客服电话: 4000-466-788

联系人: 陈东

网址: <http://www.66zichan.com/>

(82) 北京增财基金销售有限公司

注册地址: 北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

法定代表人: 罗细安

客服电话: 400-001-8811

联系人: 史丽丽

网址: <http://www.zcvc.com.cn/>

(83) 北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址: 北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址: 北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人: 赵荣春

联系人: 高静

电话: 010-56183769

客服电话: 400-893-6885

网址: [www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

(84) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址: 上海市黄浦区中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人: 冯修敏

客服电话: 400-820-2819

联系人: 朱翔宇

网址: <http://www.chinapnr.com/>

(85) 嘉实财富管理有限公司

注册地址: 上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心办公楼二期 46 层 4609-10 单元

法定代表人: 赵学军

客服电话: 400-021-8850

联系人: 余永键

网址: <http://www.harvestwm.cn/>

(86) 泰诚财富基金销售(大连)有限公司

注册地址: 辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

法定代表人: 林卓

客服电话: 400-6411-999

联系人: 张晓辉

网址: <http://www.taichengcaifu.com>

(87) 上海利得基金销售有限公司

注册地址: 上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

法定代表人: 盛大

客服电话: 400-858-0298

联系人: 徐鹏

网址: <http://www.leadbank.com.cn>

(88) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址: 珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

法定代表人: 肖雯

客服电话: 020-89629066

联系人: 吴煜浩

网址: [www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

(89) 北京恒天明泽基金销售有限公司

地址: 北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人: 梁越

客服电话: 4008-980-618

联系人: 王海烨

网址: [www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

(90) 北京乐融多源投资咨询有限公司

地址: 北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603

法定代表人: 董浩

客服电话: 400-068-1176

联系人: 于婷婷

网址: [www.jimubox.com](http://www.jimubox.com)

(91) 大泰金石投资管理有限公司

地址: 南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室

法定代表人: 袁顾明

客服电话: 021-22267982

联系人: 朱真卿

网址: [www.dtfortune.com](http://www.dtfortune.com)

(92) 上海陆金所资产管理有限公司

地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人: 郭坚

客服电话: 4008 6666 18

联系人: 何雪

网址: <https://www.lu.com>

(93) 宜信普泽投资顾问(北京)有限公司

地址: 北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

法定代表人: 沈伟桦

客服电话: 400-6099-200

联系人: 刘梦轩

网址: <http://www.yixinfund.com/>

(94) 上海凯石财富基金销售有限公司

地址: 上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

法定代表人: 陈继武

客服电话: 4000-178-000

联系人: 李晓明

网址: <http://www.vworks.com.cn>

(95) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司

地址: 北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

法定代表人: 彭运年

客服电话: 4008-909-998

联系人: 王莅晨

网址: <http://www.jnlc.com/>

(96) 深圳富济财富管理有限公司

地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

法定代表人: 齐小贺

客服电话: 0755-83999907

联系人: 马利佳

网址: [www.jinqianwo.cn](http://www.jinqianwo.cn)

(97) 奕丰金融服务（深圳）有限公司

地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

法定代表人：TAN YIK KUAN

客服电话：400-684-0500

联系人：叶健

网址：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

(98) 浙江金观诚财富管理有限公司

地址：杭州市拱墅区登云路 45 号（锦昌大厦）1 幢 10 楼 1001 室

法定代表人：徐黎云

客服电话：400-068-0058

联系人：孙成岩

网址：[www.jincheng-fund.com](http://www.jincheng-fund.com)

(99) 上海大智慧财富管理有限公司

地址：上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 10-11 楼

法定代表人：申健

客服电话：021-20219931

联系人：施燕华

网址：<https://8.gw.com.cn>

(100) 北京广源达信投资管理有限公司

地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 楼浦项中心 B 座 19 层

法定代表人：齐剑辉

客服电话：400-623-6060

联系人：崔丁元

网址：<https://www.niuniufund.com/>

(101) 北京汇成基金销售有限公司

地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

联系人：丁向坤

网址：[www.fundzone.cn](http://www.fundzone.cn)

### 3、场内销售机构

具有开放式基金销售资格的、经中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会

员可成为本基金的场内销售机构，相关信息同时通过上海证券交易所网站

[www.sse.com.cn](http://www.sse.com.cn) 登载。

基金管理人可以根据需要，增加其他符合要求的机构销售本基金，并按照相关规定及时公告。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

电话：010-50938782

传真：010-50938907

联系人：赵亦清

（三）出具法律意见书的律师事务所

通力律师事务所

地址：上海市银城中路 68 号 时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：王利民

经办律师：秦悦民、王利民

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：李丹

经办注册会计师：陈玲、傅琛慧

电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：傅琛慧

四、基金的名称

本基金的名称：海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

五、基金的类型

基金类型：股票型、契约型开放式

六、基金的投资目标

通过投资于上证非周期行业 100ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。

## 七、基金的投资方向和范围

本基金投资于上证非周期行业 100ETF、上证非周期行业 100 指数成份股和备选成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。其中投资于上证非周期行业 100ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## 八、基金的投资策略

本基金通过主要投资于上证非周期行业 100ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数的表现。建仓完成后，正常情况下投资于上证非周期行业 100ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。建仓期结束后，在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。在目标 ETF 日均跟踪偏离度符合其基金合同所设定目标的前提下，如因指数编制规则调整等其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

本基金投资于上证非周期行业 100ETF 的方式以申购和赎回为主，但在上证非周期行业 100ETF 二级市场流动性较好的情况下，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF。

法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### 1. 决策依据

有关法律、法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

### 2. 投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责制定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理负责日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购赎回清单的编制决策。

### 3. 投资程序

研究支持、投资决策、组合构建、交易执行、投资绩效评估及组合维护等流程的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

1) 研究支持：定量研究团队依托基金管理人整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果，开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、目标 ETF 二级市场的流动性和折溢价分析、成分股流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

- 2) 投资决策：投资决策委员会依据定量研究团队提供的研究报告，定期或遇重大事项时召开投资决策会议，决定相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理的日常决策。
- 3) 组合构建：根据标的指数情况，结合研究支持，基金经理构建以目标 ETF 为主的投资组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，降低买入成本、控制投资风险。
- 4) 交易执行：交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。
- 5) 投资绩效评估：定量研究团队定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检视投资策略，进而调整投资组合。
- 6) 组合维护：基金经理将跟踪目标 ETF 及标的指数变动，结合成份股基本面情况、成份股及目标 ETF 流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资管理体制和程序做出调整，并在基金招募说明书中列示。

#### 4. 投资组合管理

##### 1) 构建投资组合

构建本基金投资组合的过程主要分为三步：确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。

- (1) 确定目标组合：基金管理人通过主要投资于目标 ETF 及标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，以紧密跟踪标的指数的表现。通常情况下，投资于上证非周期行业 100ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%。
- (2) 确定建仓策略：基金经理根据对成份股流动性、目标 ETF 流动性、公司基本面等因素的分析，确定合理的建仓策略。
- (3) 逐步调整：确定目标组合及建仓策略后，基金经理在规定时间内采用适当的方法构建和调整实际组合直至达到跟踪指数要求。

##### 2) 日常投资组合管理

- (1) 对目标 ETF 二级市场流动性及折溢价进行跟踪与分析，制订目标 ETF 份额的申购赎回、二级市场买卖策略。

##### (2) 标的指数成份股日常跟踪

当成份股发生增发、配股、分红等情况或其他可能会影响成份股在指数中权重的行为时，基金管理人将分析这些信息对指数的影响，进而进行组合调整分析，及时调整股票投资组合。

##### (3) 标的指数的跟踪与分析

如果出现标的指数成分股临时调整、编制方法调整或其他可能影响组合跟踪效果的情形，基金管理人将分析调整对所跟踪标的指数的影响，并及时制定相应的投资组合调整策略。

##### (4) 申购赎回调整

本基金将根据本基金的申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，对投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

（5）投资组合的调整：利用数量化分析等方法，寻找将实际组合调整到目标组合的最优方案，确定组合调整及交易策略。

### 3) 定期投资组合管理

基金管理人将定期进行投资组合管理，主要完成下列事项：

（1）本基金投资组合将根据标的指数的编制规则、备选股票的预期及调整公告，分析并制定投资组合调整策略，尽量减少因成份股变动所带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

（2）定期分析基金与标的指数表现的偏离，并对跟踪误差等进行分析，确定跟踪误差来源，优化指数跟踪方案。

（3）根据基金合同中基金管理费、基金托管费等的支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行定期支付现金的准备。

### 4) 投资绩效评估

（1）每日对基金的绩效评估进行，分析基金跟踪偏离度；

（2）每月末，定量研究团队对本基金的运行情况进行量化评估；

（3）每月末，基金经理根据评估报告分析本基金的偏离度和跟踪误差产生原因、现金的控制情况、标的指数调整成份股前后的操作、以及成分股未来成份股的变化等。

## 九、 基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：上证非周期行业 100 指数收益率  $\times$  95% + 活期存款利率（税后） $\times$  5%

如果目标 ETF 变更业绩比较基准、或上证非周期行业 100 指数的编制单位变更或停止上证非周期行业 100 指数的编制及发布、或上证非周期行业 100 指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致上证非周期行业 100 指数不宜继续作为业绩比较基准的组成部分，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出，或目标 ETF 标的指数发生变更，基金管理人认为有必要作相应调整时，基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后，变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。

## 十、 基金的风险收益特征

本基金属 ETF 联接基金，属于高风险、高预期收益的投资品种。同时本基金为上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金的联接基金，具有与上证非周期行业 100 指数相似的风险收益特征。

## 十一、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 11 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止至 2016 年 9 月 30 日（“报告期末”）。

### 1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额（元） 占基金总资产的比例（%）

1 权益投资 3,519.00 0.01

其中：股票 3,519.00 0.01

2 基金投资 22,314,615.92 91.54

3 固定收益投资 --

其中：债券 --

资产支持证券 --

4 贵金属投资 --

5 金融衍生品投资 --

6 买入返售金融资产 --

其中：买断式回购的买入返售金融资产 --

7 银行存款和结算备付金合计 2,033,629.94 8.34

8 其他资产 26,102.99 0.11

9 合计 24,377,867.85 100.00

### 2 期末投资目标基金明细

序号 基金名称 基金类型 运作方式 管理人 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

1 上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金 股票型 交易型开放式 海富通基金管理有限公司 22,314,615.92 92.52

### 3 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码 行业类别 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

A 农、林、牧、渔业 --

B 采矿业 --

C 制造业 --

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 3,519.00 0.01

E 建筑业 --  
F 批发和零售业 --  
G 交通运输、仓储和邮政业 --  
H 住宿和餐饮业 --  
I 信息传输、软件和信息技术服务业 --  
J 金融业 --  
K 房地产业 --  
L 租赁和商务服务业 --  
M 科学研究和技术服务业 --  
N 水利、环境和公共设施管理业 --  
O 居民服务、修理和其他服务业 --  
P 教育 --  
Q 卫生和社会工作 --  
R 文化、体育和娱乐业 --  
S 综合 --  
合计 3,519.00 0.01

4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600021	上海电力	300	3,519.00	0.01

5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

## 11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

### 11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

## 12 投资组合报告附注

12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 12.3 其他资产构成

序号 名称 金额（元）

1 存出保证金 542.91

2 应收证券清算款 3,431.25

3 应收股利 -

4 应收利息 366.59

5 应收申购款 21,762.24

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 26,102.99

12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 流通受限情况说明

1 600021 上海电力 3,519.00 0.01 重大事项

## 十二、 基金的业绩

基金业绩截止日为 2016 年 9 月 30 日。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一) 本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表：

阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准收益率标准差(4)	(1) - (3)	(2) - (4)
2011 年 4 月 27 日 (基金合同生效日) - 2011 年 12 月 31 日	-25.80%	1.14%	-28.79%	1.27%		
	2.99%	-0.13%				

2012 年 1 月 1 日 - 2012 年 12 月 31 日 -0.13% 1.16% -0.50% 1.22% 0.37% -0.06%

2013 年 1 月 1 日 - 2013 年 12 月 31 日 5.40% 1.19% 4.59% 1.22% 0.81% -0.03%

2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 12 月 31 日 38.16% 1.08% 37.47% 1.10% 0.69% -0.02%

2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 12 月 31 日 11.68%

2.48%

14.67%

2.64%

-2.99%

-0.16%

2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日 -19.17% 1.83% -19.17% 1.95% 0.00% -0.12%

2011 年 4 月 27 日 (基金合同生效日) - 2016 年 9 月 30 日 0.70% 1.53% -2.18% 1.62%

2.88% -0.09%

(二) 本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图：

(2011 年 4 月 27 日至 2016 年 9 月 30 日)

注：按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同同生效之日起三个月。截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十一部分（二）投资范围、（六）投资限制中规定的各项比例。

### 十三、 基金的费用和税收

#### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

#### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、基金管理人的管理费

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

$H$  为每日应计提的基金管理费

$E$  为前一日的基金资产净值 - 所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后的余额，若为负数，则  $E$  取 0

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### 2、基金托管人的托管费

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.1% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

$H$  为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值-所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后的余额, 若为负数, 则 E 取 0

基金托管费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令, 基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等, 支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 3—8 项费用, 根据有关法规及相应协议规定, 按费用实际支出金额列入当期费用, 由基金托管人从基金财产中支付。

### (三) 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
- 3、基金合同生效前的相关费用, 包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### (四) 费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后, 可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率, 须召开基金份额持有人大会审议; 调低基金管理费率、基金托管费率等费率, 无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

### (五) 基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体, 其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 十四、对招募说明书更新部分的说明

海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求, 结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动, 对本基金原招募说明书进行了更新, 主要更新的内容如下:

#### 一、“第三节 基金管理人”部分:

1. 增加了杨明先生的简历。
2. 删除了阎小庆先生的简历。

3. 更新了投资决策委员会的相关信息。

二、“第四节 基金托管人”部分：更新了基金托管人的相关信息。

三、“第五节 相关服务机构”部分：

1. 对部分场外销售机构的相关信息进行了更新。

2. 更新了注册登记机构的信息。

3. 更新了审计基金财产的会计师事务所的信息。

四、“第八节 基金份额的申购与赎回”部分，更新了申购份额与赎回金额的计算。

五、“第九节 基金的投资”和“第十节 基金的业绩”部分，根据 2016 年第三季度报告，

更新了基金投资组合报告和基金业绩的内容，相关数据截止期为 2016 年 9 月 30 日。

海富通基金管理有限公司

2016 年 12 月 10 日